

Accorde Alapkezelő Zrt.

Aforizma Származtatott Részalap
2022. I. Féléves jelentés

(Időszak: 2021.12.31 - 2022.06.30.)

I. Vagyonkimutatás indulás: 2021.12.31. Vége: 2022.06.30.

	Instrumentum	Érték HUF- ban	Arány (%)	Érték HUF- ban	Arány (%)
Banki egyenlegek		2021.12.31		2022.06.30	
<i>Deviza</i>					
	Aforizma Alap UniCredit EUR	1,299	0.00	6,064,947	0.40
	Aforizma Alap UniCredit HUF	152,124,471	10.72	6,644,334	0.44
	Aforizma Alap UniCredit PLN	381	0.00	408	0.00
	Aforizma Alap UniCredit RON	10,284	0.00	11,216	0.00
	Aforizma Alap UniCredit USD	5,291	0.00	6,175	0.00
	Aforizma SAXO HUF 8516151	74,621,824	5.26	97,911,517	6.48
	<i>Deviza összesen</i>	<i>226,763,550</i>	<i>15.99</i>	<i>110,638,597</i>	<i>7.32</i>
	<i>Betét összesen</i>	<i>0</i>	<i>0.00</i>	<i>285,000,000</i>	<i>18.86</i>
	<i>Betét összesen</i>	<i>0</i>	<i>0.00</i>	<i>285,000,000</i>	<i>18.86</i>
Banki egyenlegek összesen		226,763,550	15.99	395,638,597	26.18
Átruházható értékpapírok					
<i>Állampapír</i>					
	D220309	330,003,725	23.26	0	0.00
	D220504	27,909,519	1.97	0	0.00
	D220629	49,715,640	3.50	0	0.00
	D220824	99,533,429	7.02	100,436,396	6.65
	D221019	41,046,096	2.89	41,231,022	2.73
	D230222	0	0.00	332,524,011	22.01
	MÁK 2031/A	0	0.00	255,185,856	16.89
	MÁK 2032/A	0	0.00	103,526,540	6.85
	<i>Állampapír összesen</i>	<i>548,208,409</i>	<i>38.65</i>	<i>832,903,825</i>	<i>55.12</i>
<i>Részvény,ETF,Unit</i>					
	AutoWallis	24,191,880	1.71	0	0.00
	CIG Pannónia Életbiztosító	0	0.00	6,822,666	0.45
	Duna House Részvény	126,113,344	8.89	87,699,472	5.80
	Magyar Telekom	181,060,000	12.76	18,672,640	1.24
	MOL Nyrt.	126,000,000	8.88	0	0.00
	OTP Bank Nyrt.	0	0.00	16,844,000	1.11
	Richter Gedeon Nyrt.	69,800,000	4.92	47,810,000	3.16
	<i>Részvény,ETF,Unit összesen</i>	<i>527,165,224</i>	<i>37.16</i>	<i>177,848,778</i>	<i>11.77</i>

Vállalati kötvény	PCRK 2024/A	117,697,015	8.30	116,190,063	7.69
Vállalati kötvény összesen		117,697,015	8.30	116,190,063	7.69
Átruházható értékpapírok összesen		1,193,070,648	84.11	1,126,942,666	74.58
Követelések					
<i>Köv/Köt</i>					
	D220309	1,648,031	0.12	0	0.00
	D220504	145,999	0.01	0	0.00
	D220629	184,779	0.01	0	0.00
	D220824	194,832	0.01	641,221	0.04
	D221019	100,000	0.01	0	0.00
	D230222	0	0	761,854	0.05
	Duna House Részvény MAGYAR FORINT	0	0	3,610,416	0.24
	OTP Bank Nyrt.	0	0	43,198,100	2.86
	Richter Gedeon Nyrt.	0	0	-30,209,853	-2.00
Követelések összesen		2,068,046	0.15	20,352,505	1.35
Egyéb eszközök					
	CFD	1,018,036	0.07	0	0.00
	CFD Összesen	1,018,036.00	0.07	0.00	0.00
	Határidős	-3,266,442	-0.23	-30,938,181	-2.05
	Határidős összesen	-	-0.23	-	-2.05
		3,266,442.15		30,938,180.68	
Egyéb eszközök összesen		-2,248,406	-0.16	-30,938,181	-2.05
Eszközök összesen		1,419,653,838	100.08	1,511,995,587	100.06
Kötelezettségek					
<i>Díjak</i>					
	Felügyeleti díj	-124,336	-0.01	-127,654	-0.01
	Könyvelési díj	-192,066	-0.01	-189,978	-0.01
	Könyvvizsgálói díj	-555,106	-0.04	-283,530	-0.02
	Különadó	-176,180	-0.01	-182,862	-0.01
	Letétkezelői díj	-86,968	-0.01	-89,720	-0.01
	Díjak összesen	-1,134,656	-0.08	-873,744	-0.06
Kötelezettségek összesen		-1,134,656	-0.08	-873,744	-0.06
Nettó eszközérték		1,418,519,182	100	1,511,121,843	100

II. Forgalomban lévő befektetési jegyek száma az időszak elején és végén:

	2021.12.31	2022.06.30
Forgalomban lévő befektetési jegyek száma (db)	928,631,628	928,631,628

III. Egy jegyre jutó Nettó eszközérték az időszak első és utolsó forgalmazási napján (befektetési jegy névértéke 1 HUF)

	2021.12.31	2022.06.30
Egy jegyre jutó nettó eszközérték (HUF)	1.527537	1.627256

IV. Befektetési alap eszközállományának összetétele (nyitó állomány és záró állomány)

Befektetési alap eszközállományának összetétele					
Megnevezés	Nyitó állomány	(%)*	Záró állomány	(%)*	
Tőzsdén hivatalosan jegyzett értékpapírok	527,165,224	37.16	177,848,778	11.77	
Más szabályozott piacon forgalmazott átruházható értékpapírok	0	0.00	0	0.00	
A közelmúltban forgalomba hozott átruházható értékpapírok	0	0.00	0	0.00	
Egyéb átruházható értékpapírok	0	0.00	0	0.00	
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	665,905,424	46.94	949,093,888	62.81	
* A Nettó eszközérték százalékos arányában					

Az Alap befektetési politikájában, eszközeinek stratégiai összetételében nem történt érdemi változás.

V. Az ABA féléves beszámolójában nyújtandó információ az értékpapír kölcsön ügyletekről

Globális adatok

Kölcsönbe adott értékpapírok	ISIN	Ügylet kezdete	Ügylet vége	Ügylet értéke	Kölcsönözhető eszközállomány arányában (%)	Nettó eszközérték arányában (%)
D220824	HU0000523774	2021.10.14	2022.08.18	101,400,000	100.00	6.71
D230222	HU0000524038	2022.03.03	2023.02.16	210,940,000	60.78	13.96
D230222	HU0000524038	2022.03.03	2023.02.16	52,730,000	15.19	3.49
D230222	HU0000524038	2022.03.03	2023.02.16	83,370,000	24.02	5.52
Összesen				448,440,000		29.68

Koncentrációra vonatkozó adatok

- A tíz legnagyobb biztosítékkibocsátó:

Biztosítékkibocsátó neve	Eszköz neve	Darabszám
Concorde Értékpapír Zrt.	Concorde Értékpapír Zrt.Elsobbségi Törzsrészvény	135,000
Accorde Alapkezelő Zrt.	Accorde Spartan Görög Részvényalap 'A' sorozat	68,052,548
	Accorde Selection Részvényalap 'A' sorozat	72,000,000
	Accorde Prizma Alap 'A' sorozat	436,000,000
OTP Alapkezelő Zrt.	OTP Supra Származtatott Befektetési Alap	8,000,000
Masterplast	Masterplast Nyrt	13,200
Magyar Államkincstár	D220824	32,420,000

- A tíz legfontosabb szerződő fél:

Szerződő fél	Kölcsönbe adott értékpapírok	ISIN	Ügylet kezdete	Ügylet vége	Ügylet értéke
1. ügyfél	D220824	HU0000523774	2021.10.14	2022.08.18	101,400,000
2. ügyfél	D230222	HU0000524038	2022.03.03	2023.02.16	210,940,000
3. ügyfél	D230222	HU0000524038	2022.03.03	2023.02.16	52,730,000
4. ügyfél	D230222	HU0000524038	2022.03.03	2023.02.16	83,370,000

Az értékpapírtitokra és adatvédelemre vonatkozó szabályozást figyelembe véve a szerződő felek személyét nem fedhetjük fel, őket számozott ügyfélként jelöljük. Minden szám külön ügyletet jelöl.

Biztosítékokra vonatkozó adatok

Biztosíték típusa	Lejáratil profil Nyitott lejáratú		
	HUF	EUR	USD
Biztosíték pénzname			
Kollektív befektetési formák	837,729,693	0	0

A kapott biztosítékok letéti őrzése

Letétkezelő neve	Őrzött biztosítékok összege (HUF)
Concorde Értékpapír Zrt.	837,729,693

Értékpapír kölcsönökre vonatkozó adatok

Kölcsönbe adott értékpapírok	Lejáratil profil	
	90 nap alatt (HUF)	91 – 365 nap (HUF)
Hitelviszonyt megtestesítő értékpapírok	101,400,000	347,040,000

Az értékpapír kölcsönzési ügyletek hozamára és költségeire vonatkozó adatok

Kölcsönbe adott értékpapírok	ISIN	Ügylet kezdete	Ügylet vége	Ügylet lejáratkorigi teljes díja (HUF)	Eddig felszámolt díj (HUF)	Eddig felszámolt díj (%)
D220824	HU0000523774	2021.10.14	2022.08.18	759,600	638,755	84.09
D230222	HU0000524038	2022.03.03	2023.02.16	1,350,636	328,012	24.29
D230222	HU0000524038	2022.03.03	2023.02.16	337,627	81,995	24.29
D230222	HU0000524038	2022.03.03	2023.02.16	533,813	129,640	24.29

VI. Kockázati profil

Az Alap kockázati mutatója mutatója: 4.

A mutató az alap heti hozamainak ingadozását veszi alapul. Az alap 2018 -ban indult.

A kockázati besorolást az alap által megcélzott referenciaindex múltbeli hozamaiból vagy az alap által megcélzott piaci szegmenst tükröző portfólió múltbeli hozamaiból számított

szórás érték alapján számszerűsítettük, a múltbeli adatok azonban nem szükségszerűen megbízható mutatói a jövőbeli kockázati profilnak.

A feltüntetett kockázat/nyereség profil nem marad garantáltan változatlan, és az Alap kategorizálása idővel módosulhat.

A legalacsonyabb kategória nem jelent kockázatmentes befektetést.

Alap neve	Dátum	Nettó összesített kockázati kitettség mértéke (%)
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2022.01.31	104.11
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2022.02.28	165.11
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2022.03.31	152.43
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2022.04.29	112.29
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2022.05.31	154.27
<i>Aforizma Származtatott Részalap</i>	2022.06.30	111.22

A fenti táblázat mutatja az ABA által alkalmazott tőkeáttétel mértékének változását a 2022. június hó végi állapota alapján.

Az Alap kezelési szabályzata alapján, az alap által felvehető maximális mértékű tőkeáttétel fedezetére az alapban lévő rövid lejáratú likvid állampapírok szolgálnak.



Budapest, 2022. augusztus 31.

Gyurcsik Attila
Vezérigazgató

Mezei Magdolna
Ügyvezető igazgató

Jelen dokumentum saját kezű aláírásképet biztonsági okból nem tartalmaz. Jelen dokumentum tartalma az eredeti, cégszerű aláírással és egyéb felelős személy aláírásával ellátott papír alapú dokumentum tartalmával mindenben egyező és sajátkezű aláírás nélkül is cégszerűnek illetve hitelesnek tekinthető.